

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de julio de 2024.

NTEMPG					
Fondo Banorte 12, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Mediano Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S4(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$1,645,589,936	91.79 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$386,797,546	21.58 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$349,587,474	19.50 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$294,479,952	16.43 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$249,013,651	13.89 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$209,823,614	11.70 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$155,887,699	8.70 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$37,860,284	2.11 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,540,062	1.09 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,320,222	1.02 %
Total Deuda Gubernamental				\$1,683,450,220	93.91 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$1,683,450,220	93.91 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$1,683,450,220	93.91 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$54,632,847	3.05 %
LF	BONDEF	261231	AAA(mex)	\$54,632,847	3.05 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$54,632,730	3.05 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$54,632,730	3.05 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$109,265,577	6.09 %
TOTAL DE CARTERA:				\$1,792,715,797	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.2339%		
Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

